

# **FDAX-TRADING-STRATEGIE**

## **Operativa de CFDs (DAX) con el fin de operar el FDAX**

### **Actualizado April 2020**

El siguiente conjunto completo de reglas cubre todos los movimientos dentro del rango de operaciones diarias. A veces el sentido común decide o en caso de incertidumbre no se realiza ninguna operación.

Siguiendo estrictamente las instrucciones se obtiene un alto beneficio a largo plazo. Un sistema del trading es solo parte de un plan de negocios. Por lo tanto, la implementación requiere mucho más que solo las reglas.

### **Movimientos de precios históricos**

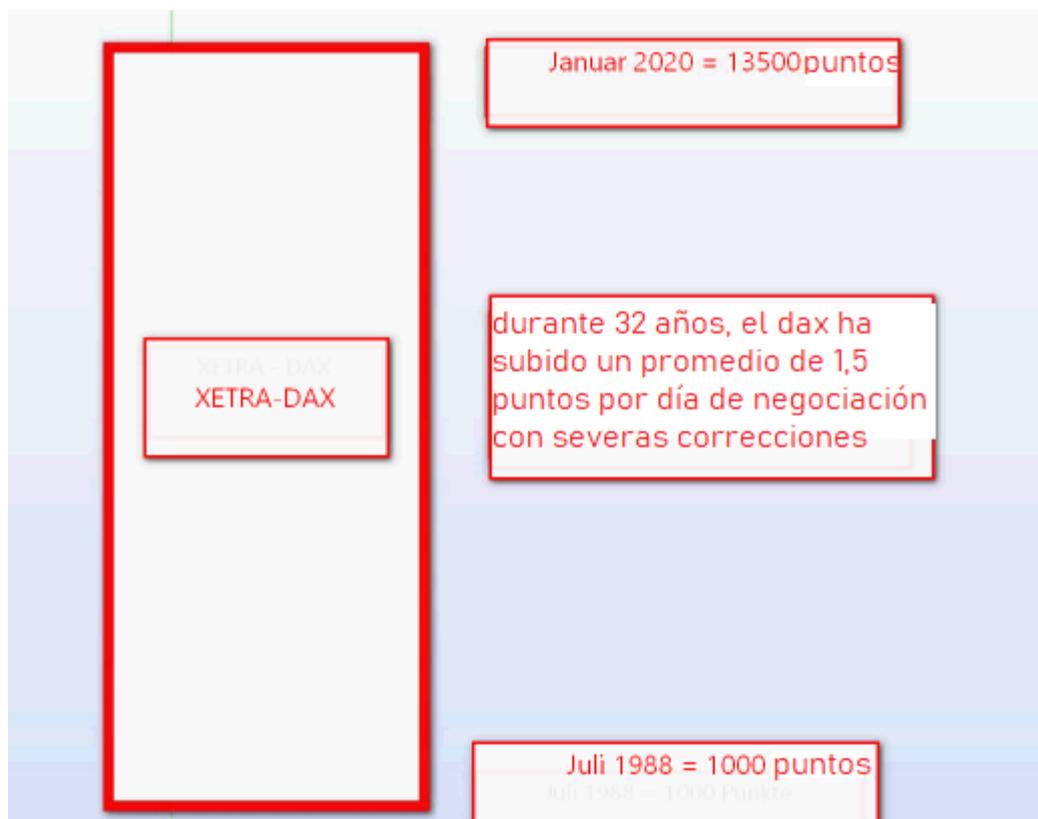




Gráfico anual dividido en 1000 puntos como referencia. Cada máximo anual en o por encima del punto de referencia fue seguido por una corrección de + 1000 Puntos





Las correcciones se realizan en cualquier marco de tiempo (timeframe) El rango de negociación diario del futuro del DAX (FDAX) tiene un promedio de alrededor dos por ciento. En realidad, sin embargo, el precio a menudo cubre distancias mucho más largas debido a las idas y venidas a corto plazo. Esto es exactamente de lo que se beneficia la Estrategia de Reversión a la Media presentada aquí. Estudios estadísticos del autor muestran que hasta en el 90 por ciento de todos los días de negociación, el precio se eleva por encima del precio de cierre del día anterior, pero en realidad cierra por encima de él en sólo el 55 por ciento de los casos. Por el contrario el precio cotiza un 90% debajo del precio de cierre del día anterior pero cierra en menos de la mitad de los casos también abajo. El enfoque comercial presentado en este artículo se deriva de lo que antecede ya presentado en 2011 por la VTAD como un proyecto de investigación (<https://www.vtad.de/node/1446>).

Por supuesto, sólo las estrategias de trading con un alto valor estadístico en el pasado genera realmente beneficios en el uso real. Para verificar la

sostenibilidad un simple forward test ha sido realizado entre 2010 a 2013 con un máximo de seis DAX CFDs y un capital inicial de 2000. El resultado era un aumento de capital hasta 8931€. Hubo varios drawdowns siendo el máximo 1400 puntos durante el Flash Crash. Por lo tanto, en los años siguientes la estrategia discrecional ha sido mejorada considerablemente sobre todo el Management del riesgo que impide grandes pérdidas.

La estrategia de trading a corto plazo se basa esencialmente en la reversión de la media, pero también se negocian los días de tendencia.

## **Horas de operativa**

El día operativo comienza a las 8:00h hasta las 22:00h y se divide en la mañana de 8:00h hasta las 14:30h y por la tarde de 14:45h hasta las 22:00h

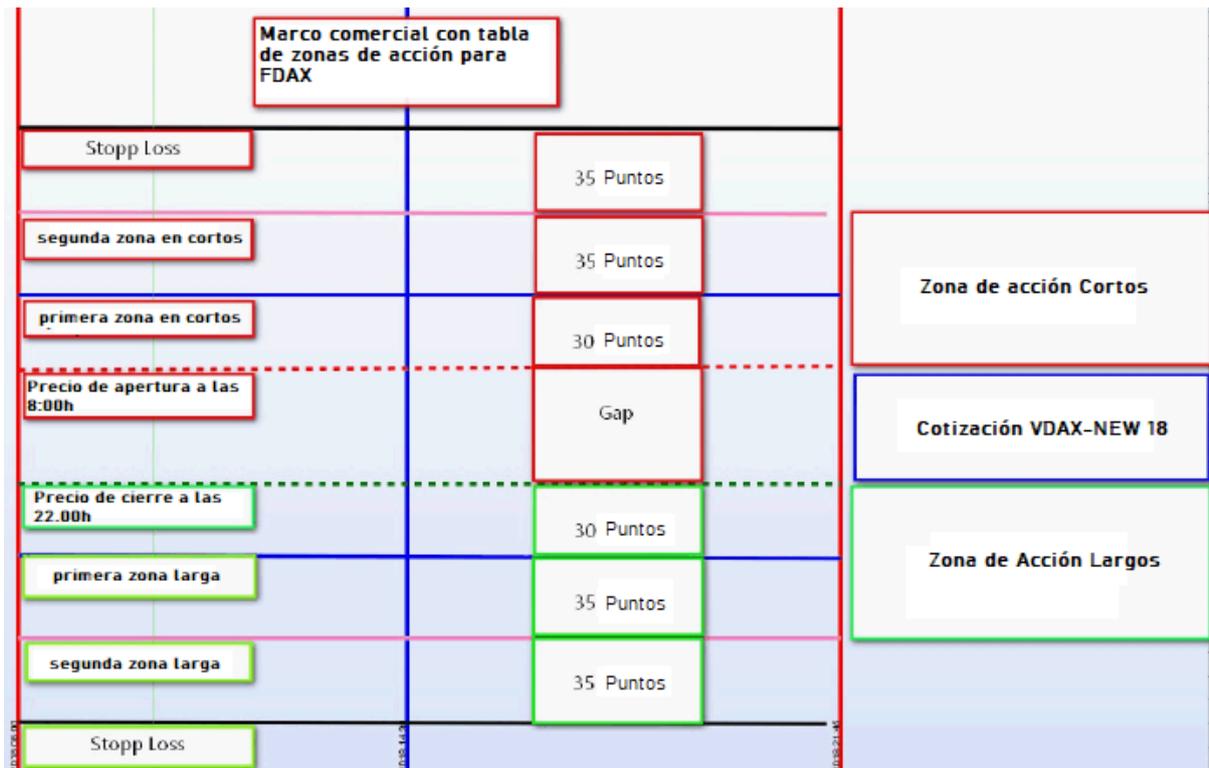
Los enfoques comerciales son diferentes y, por lo tanto, los traders a tiempo parcial pueden beneficiarse de la estrategia

## **Trading por la mañana**

### **Zonas de acción**

Diariamente se crea un marco de operaciones con zonas de acción dependientes de la volatilidad, que constituyen la base de la estrategia. Las zonas se basan en los muchos años de experiencia del autor para determinar en qué lugar del rango de trading forman la mayoría de las correcciones hacia la tasa media y más allá. En consecuencia, las zonas sirven para identificar puntos favorables para la apertura de posiciones largas o cortas. Después de la primera cotización del FDAX a las 8:00am CET, hay cinco referencias clave que son relevantes para nuestras zonas de acción:

1. Precio de cierre Xetra-DAX a las 17:30h CET del día anterior
2. Precio de cierre FDAX a las 22:00 del día anterior
3. Precio de apertura FDAX como precio de referencia para el día de negociación actual
4. Precio del VDAX NEW y VIX
5. DOW JONES INDUSTRIAL FUTURO (DJIA FUT)



Marco operativo con un precio VDAX-NEW inferior al 20

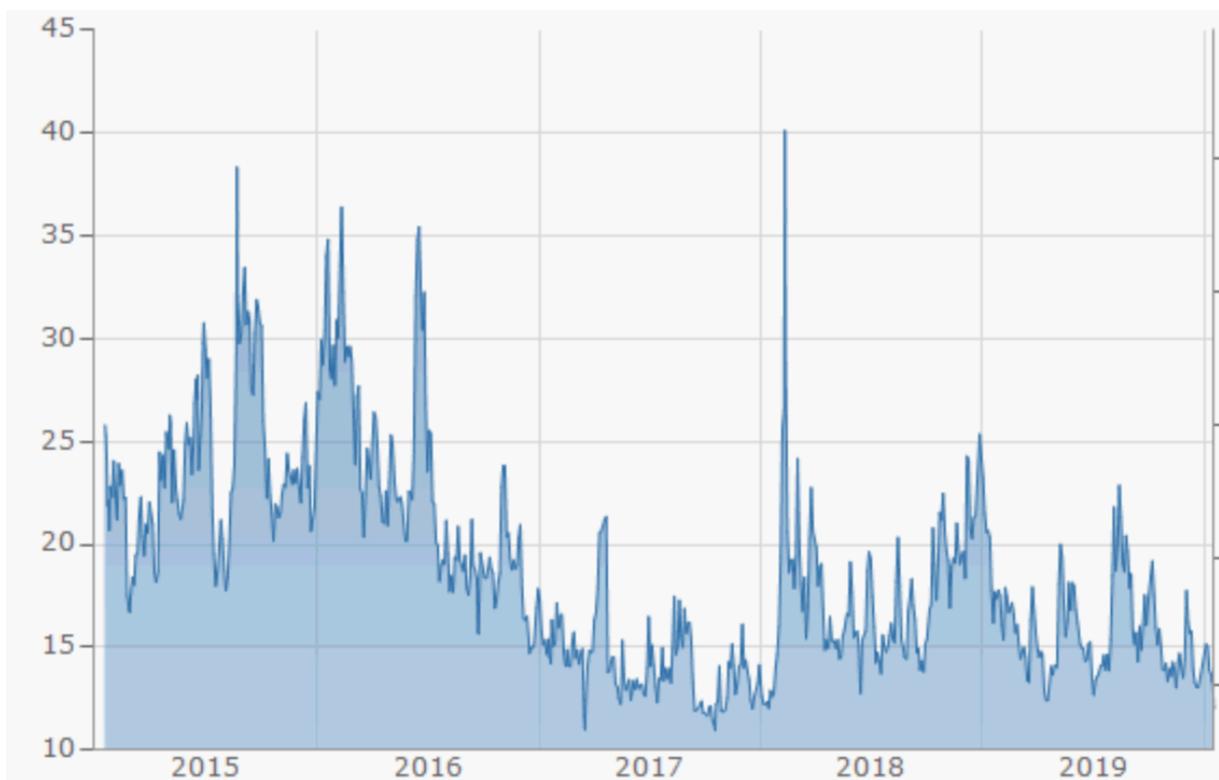
Este gráfico cubre una distribución normal del rango de trading de la mañana hasta las 14:30h. Por la tarde suele haber muchas veces una extensión del rango. Ver la operativa de la tarde. Los precios de apertura y cierre se producen con la misma frecuencia también a la inversa.

DJIA FUT es el principal indicador del trading de FDAX. Por lo tanto no pueden ser ignorados cuando se opera. En particular, los gaps a las 8:00h y el mercado de la tarde están determinados en gran medida por el DJIA FUT. Por lo tanto, siempre se hace referencia al DJIA FUT.

Dependiendo de la volatilidad, el rango de trading diario se ampliará o reducirá. Hay un ajuste flexible de la zonificación según el VDAX VDAX-NEW.

- VDAX NEW por debajo de 20 = 30 puntos para la primera zona y 35 para la segunda zona
- VDAX NEW entre 20 y 25 = 45 puntos a ambos lados

- VDAX NEW entre 25 y 30 = 50 puntos en ambos lados
- VDAX NEW entre 30 y 35 = 60 puntos en ambos lados
- VDAX NEW más de 35 = 60 puntos para cortos sin embargo primera zona para largos a 120 puntos.
- No operativa en cuanto el VDAX cotiza encima de 50



VDAX NEW 5 años

Trade Management se refiere a cualquier acción que un trader emprenda activamente para abrir una posición, obtener beneficios y minimizar el riesgo.

Apertura de la posición:

Se abrirá una posición cuando la cotización llegue a la primera zona (larga o corta). En el caso de que la primera posición llegue en pérdida hasta la segunda zona, se abrirá allí una segunda posición con doble número de contratos. La operativa desde esta segunda zona contribuye decisivamente al éxito de la estrategia. El ratio win/loss de esta posición es de 2:1.

Toma de beneficios:

Los beneficios se toman si la posición de la primera zona alcanza el precio de apertura o cierre del día anterior. Asimismo, la posición de la segunda zona se cierra con un beneficio si una posición de la segunda zona alcanza de nuevo la línea de la primera zona.



## Gestión del riesgo

### Stops fijos

Al mismo tiempo, por supuesto, la estrategia también debe limitar las posibles pérdidas. Un cierre con pérdida ocurre cuando una posición todavía abierta se mueve a la zona de pérdida previamente determinada. Esta se encuentra 35 puntos por encima o por debajo de las segundas zonas. Si las posiciones siguen abiertas a las 22:00h se cerrarán con una ganancia o una pérdida.

### Time Stops (Limite de perdida temporal))

Si las posiciones se abrieron por la mañana y siguen operando con pérdidas poco antes de las 14.30 se realiza un time stop y se cierran las posiciones. El trading se termina a las 22:00h y todas las posiciones son cerradas sea con beneficio o perdida.

Desde las 13:00h hasta las 14:45h no se abren nuevas posiciones. Esto se debe a la disminución del volumen de operaciones durante la hora del almuerzo y a la reticencia a recibir las noticias económicas de los EE.UU. a las 14:30.





## **Nuevas aperturas de posiciones y proteccion de beneficio.**

- Habiendo obtenido beneficios de la primera/segunda o ambas zonas se pueden abrir nuevas posiciones. Para asegurar las ganancias o reducir las pérdidas, las nuevas aperturas de posiciones están sujetas a un simple conjunto de reglas adicionales.
- Si se abrieron posiciones en la primera y segunda zonas, cortas o largas, y sólo se cerraron las posiciones de la segunda zona con un beneficio, entonces después de un retroceso a la segunda zona sólo se abre allí una nueva posición si el VDAX-NEW se cotiza por debajo de 17.
- Si ya se han obtenido beneficios por la mañana o una posición de la primera zona sigue abierta, entonces no se abrirán más posiciones en el período de 13:00h a 14:45h.
- Si las posiciones de la primera y segunda zona se han cerrado con éxito en un lado del gráfico, sean cortos o largos, y el precio se vuelve al otro lado del gráfico, entonces sólo la mitad de los contratos habituales se negocian allí para asegurar los beneficios. Vea el siguiente cuadro.



## Gaps (huecos)

Los gaps son movimientos que saltan un cierto rango de precios en el que no se produce ninguna cotización ni negociación. Los gaps, excepto el doble gap y el wide gap, no se negocian.

### GAP DOBLE

Este es el caso si el FDAX a las 22:00h cotiza 20+ puntos por encima o por debajo del precio de cierre del XETRA-DAX a las 17.30h y abre el día siguiente a las 8:00h con un gap de por lo menos 50 puntos en la misma dirección. En total, el gap debe ser de al menos 70 puntos para ser considerado un gap doble



El gráfico muestra que el precio de apertura se cotiza por debajo del precio de cierre de XETRA-DAX y FDAX. Después de la apertura del FDAX a las 8:00h se abre una posición larga. El objetivo es de obtener un beneficio de 50 puntos. (línea cierre FDAX día anterior)

### **Wide Gap**

Los Wide Gaps son huecos que no cumplen los requisitos de un Doble Gap pero que tienen una diferencia entre cierre y apertura de + 40 puntos. El trading comienza al cierre del día anterior, siendo entonces la primera zona de acción, con el objetivo de beneficios la apertura del precio a las 8:00h. Time Stop un poco antes de las 14:30h cuando la posición está en pérdida. Se trata de un enfoque operativo de cierre de gap inverso. Si el VDAX-NEW se cotiza por encima de 20, el trading de la Wide Gap sólo tiene lugar después de un gap mínimo de 70 puntos. No hay trading si el VDAX-NEW cotiza por encima de 25. Al lado opuesto del Wide Gap se realiza el trading normal de zonas.



Los Gaps FDAX se derivan generalmente del DJIA FUT. Especialmente en el caso de las elevadas cotizaciones del VDAX-NEW la dirección inicial es muy a menudo continuada. Se recomienda la confirmación con una vela de reversion de 5M Candlestick. No se abre ninguna posición cuando DJIA FUT se cotiza +/- 2 %. La toma de beneficios también puede tener lugar en tramos: 50% después de 30+ puntos y 50% al precio de cierre del FDAX



Al abrir una posición el precio de apertura viene a ser la primera zona. En caso de retroceso la primera zona habitual se convierte en la segunda zona. Vea grafico.

Una vez que la posición ha logrado su meta el trading normal de la zonas sera efectuado.

Para ambos enfoques del Gap la pérdida por Stop Loss también esta situado 35 puntos por debajo/encima de la segunda zona

### **Monster Gap con un hueco de más de 200 puntos.**

Si esto ocurre, entonces el trading no comenzará hasta la tarde de ese día. Razón: después de un Monster Gap, las primeras velas pueden ser muy largas con el alto riesgo de entrar en el Stop Loss.



### Aperturas de posición dependientes de noticias

En el período previo a las publicaciones importantes, como el Informe del Mercado Laboral de EE.UU. y las decisiones sobre los tipos de interés de la FED/EZB, las ganancias de precios ocurren regularmente en un entorno alcista.

El Informe del Mercado Laboral de EE.UU. se publica el primer viernes del mes a las 14:30 CET. El Comité Federal de Mercado Abierto se reúne regularmente ocho veces en un año.

Las posiciones largas se abren con la confirmación por una vela de 5M siempre cuando los DOW FUTURES (DJIA FUT) no cotizan con pérdidas.

Después de la publicación de los datos suele haber grandes oscilaciones de precios. Sólo los traders muy experimentados deberían entonces actuar, ya que depende de si los datos están significativamente por encima o por debajo de las expectativas. En este caso es esencial operar en tándem con DJIA FUT.

## Gestión del Trade: Ejemplo decisión de la FED sobre el tipo de interés a las 20:00

Después de ganar 30 puntos, el 50% de los contratos serán cerrados (Take Profit/TP). Un 50% más se liquidan poco antes de las 20:00h. En caso de un reajuste de precios, la posición inicial se incrementará en un 50% y en caso de un beneficio, el 50% se cerrará de nuevo.

Corrigiendo el precio en la segunda zona, una posición larga se duplica y el TP se hace para esta posición después de 35 puntos de beneficio.

No hay división entre la mañana y la tarde para este día. Las posiciones pueden abrirse como se muestra en el siguiente cuadro:



## Gestión de la operativa: Ejemplo de informe sobre el mercado laboral de los Estados Unidos



También se pueden realizar cierres parciales (TP), por ejemplo con 30 puntos. En el caso de reajustes, el número de puntos se incrementa. En la segunda Zona Larga doblando la posición.

## **Gestión de la operativa: Ejemplo de reunión del BCE**

El trading es similar a los datos del mercado laboral de EE.UU., pero la toma de beneficios es del 50% justo antes de las 13:45h.

## **Seguimiento de tendencias. Apertura de posiciones en coordinación con DJIA FUTURES**

Cotizan a las 8:00h los DOW FUT (DJIA FUT) y los principales índices asiáticos (China y Japón) +/- 0,5% consideramos de operar la tendencia y no la reversion a la media (mean reversion.)



Dia tendencial alcista





Dia tendencial bajista

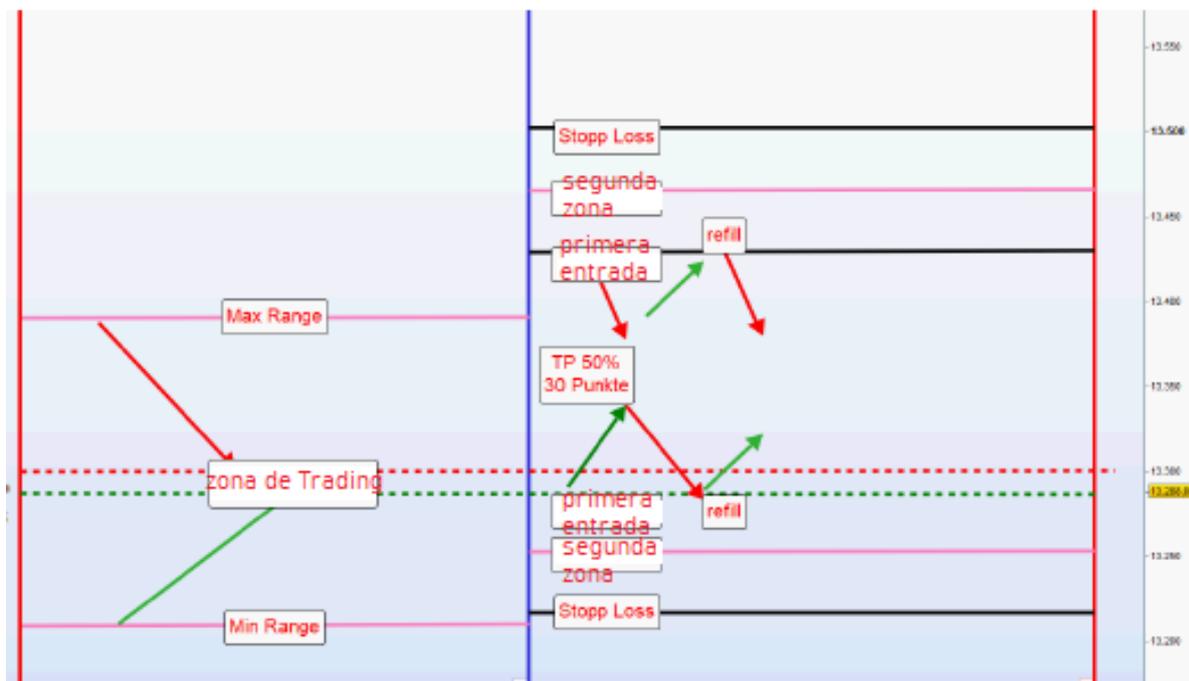
## FDAX-TRADING-STRATEGIE

### Operativa por la tarde

Muchos días de trading no han agotado su rango de negociación a las 14.30h cuando comienza la bolsa de valores de EE. UU. Por mejor orientación dibujamos el rango de negociación hasta las 14.30h como zona de valor. El trading tiene lugar cuando uno de los cinco (5) setups se presenta para abrir una posición.

1. Extensión de rango. Corto y largo.
2. Reversión a la media cuando el precio negocia a través de la línea de stop loss definida por la mañana. Corto y largo
3. El precio cruza la línea de precio de cierre del día anterior desde la parte inferior (solo largo)
4. Trading en la dirección de precio de apertura. corto y largo
5. Reversión temprana y tardía iniciada por DJIA FUT. Corto y largo

Después de marcar el máximo y el mínimo del Rango una apertura de posición es siempre, de forma análoga a la mañana, la primera zona. Sigue una segunda zona con el doblamiento de la posición y el stop loss. Por lo tanto, la gestión de operaciones por la tarde es la misma que por la mañana. Para las posiciones de los Setups 2 a 5, también se puede tomar beneficios parciales del 50% y se pueden reponer (rellenar) cuando se reinicia una posición para la entrada inicial.



Este trading tiene una tasa de éxito muy alta porque las operaciones, excepto para el setup 3, siempre ocurren cerca del máximo o mínimo del rango de operación diario. Unfair value. (Valor injusto)

La frecuencia de negociación aumenta con el incremento de la volatilidad del VDAX.

No hay operaciones por la tarde si en el momento de una posible apertura de una posición los DOW FUTURES (DJIA FUT) están por encima del 1% en beneficios o pérdidas. Cotizando el VDAX + 20 y los DJIA FUT mas/menos del 2% tampoco se opera.

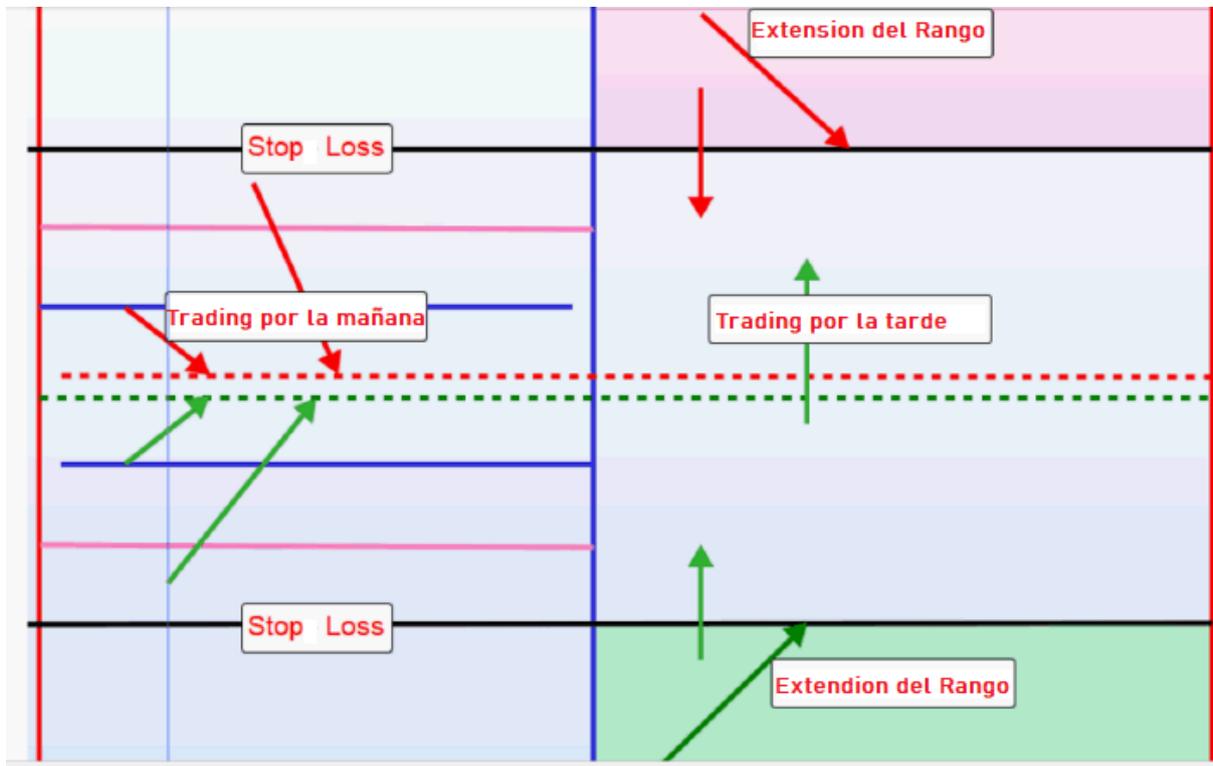
El prerequisite para el trading, excepto el Setup 3, es un rango de trading intradía de 100 puntos. Las posiciones abiertas desde la mañana, especialmente de las segundas zonas, deben negociarse a priori.

Si por la mañana ambas posiciones de la primera y segunda zona fueron cerradas con altas pérdidas, el trading en este lado del gráfico sólo tendrá lugar por la tarde si el precio fue negociado de nuevo en la segunda zona después del Stopp Loss. La razón de esta medida de seguridad es que muy a menudo, después del Stopp Loss, el precio continúa en la dirección inicial y luego puede ocurrir un día de tendencia.

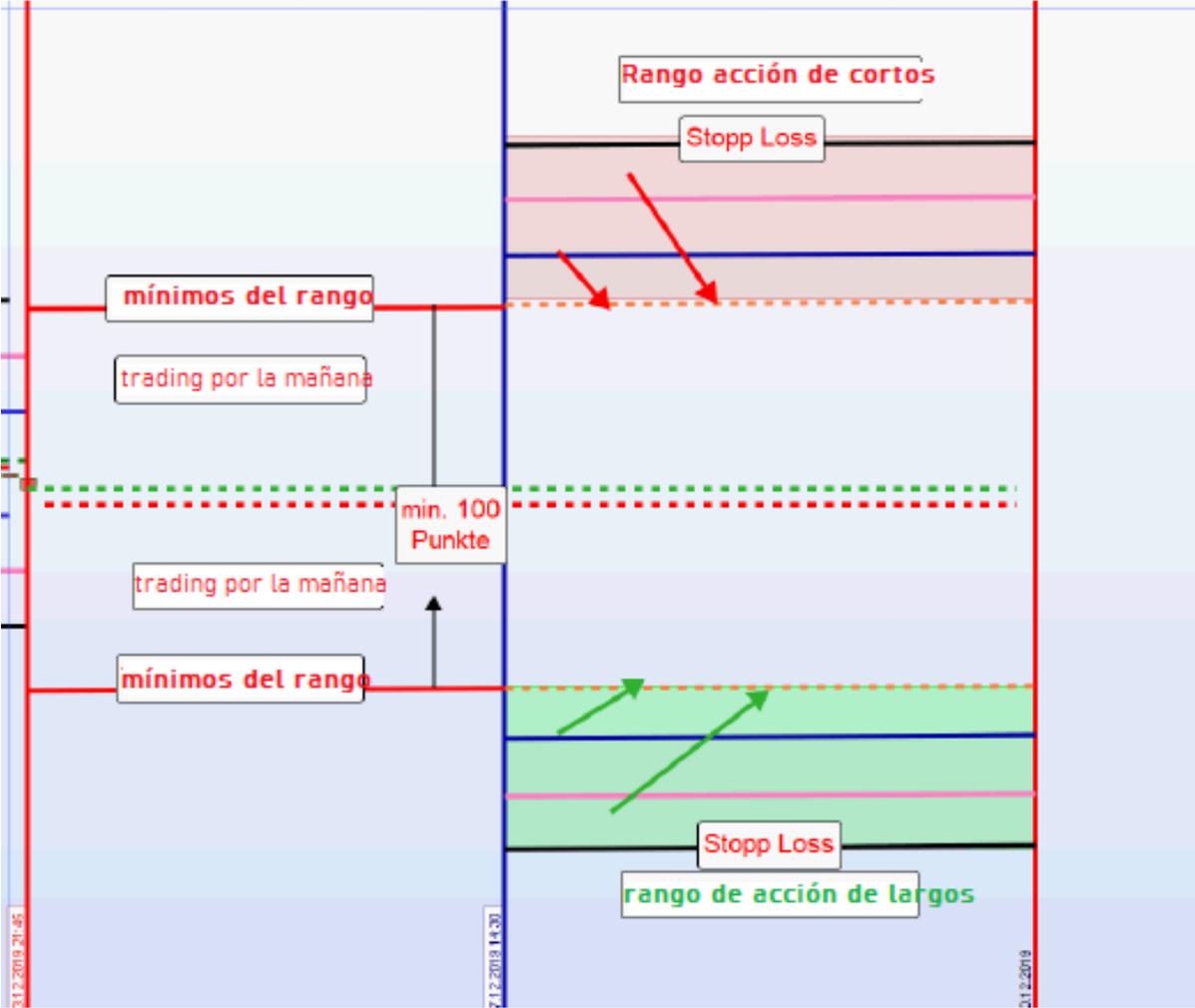




**Visión general del trading en la mañana y en la tarde**



Setup 1. Extension de rango



**Setup 2.** Reversión a la media cuando el precio negocia a través de la línea de stop loss definida por la mañana. Corto y largo





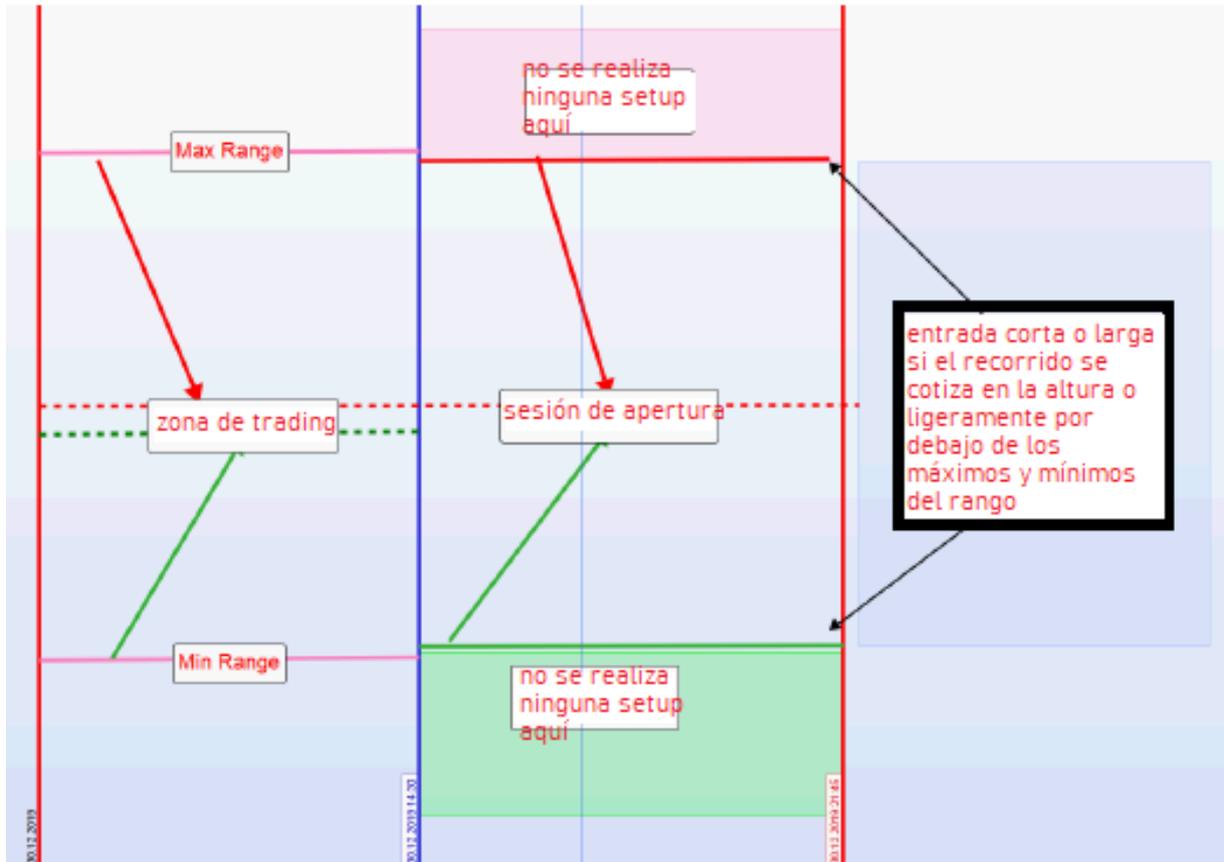
**Setup 3.** El precio cruza la línea de precio de cierre del día anterior desde la parte inferior (solo largo)





#### Setup 4. Trading en la dirección de precio de apertura. Corto y largo

Mientras todas los setups anteriores tienen especificaciones precisas para la apertura de posiciones, este tiene lugar cerca del maximo/minimo del rango intradia en la dirección del precio medio. El maximo/minimo diario también puede estar en un lado del gráfico en la primera o segunda zona. El precio también puede haber sido negociado en la zona de expansión del rango sin cerrar en esa zona.





## Múltiples Setups

A veces por la tarde existe la posibilidad de operar varios setups.



## 5. Revisiones (reversiones) iniciadas por DJIA FUT. Corto y largo

Después de las 14:30h hay ocasionalmente un día de tendencia con el precio de cierre en el punto más alto o más bajo del rango de comercio, pero también inversiones tempranas y tardías con una inversión parcial o completa del rango. Los traders experimentados pueden obtener grandes beneficios con estas inversiones, ya que no están atados a ninguna zona.

El noventa por ciento de las reversiones ocurren cuando:

1. los DOW FUTURES (DJIA FUT), antes de la apertura de la valores de EE.UU., cotizan muy altos en pérdidas/ganancias y al abrir la bolsa hay entonces un contramovimiento inmediato (Revisiones tempranas) o
2. después de las 20:00h por la toma de beneficios intradía (reversiones tardías)

Por lo general, los tres índices principales de EE.UU. (Nasdaq, S&P 500, DOW giran a la vez.



## Las evaluaciones del trading en la tarde en el año 2019 revelaron:

En 265 días de negociación, 116 órdenes fueron ejecutadas por la tarde. En total, 105 días de beneficios, 5 días de pérdidas y 6 días de break even.

Setup 1. Ganancias en 27 días de negociación/ pérdidas 1/ break even 3

Setup 2. Ganancias en 12 días de negociación/ pérdidas 0/ break even 1

Setup 3. Ganancias en 25 días de negociación/ pérdidas 1/ break even 1

Setup 4. Ganancias en 41 días de negociación/ pérdidas 3/ break even 1

Como consecuencia de esta evaluación se puede afirmar que los traders a tiempo parcial tienen la oportunidad de participar con éxito.



Regla:

Si se abre una posición en la primera zona y seguidamente el precio cruza de la primera a la segunda zona de un solo movimiento sin ninguna corrección entonces otra posición se abre solamente después de un vela de giro. Si esta vela de reversión se cierra más de 10 puntos por debajo de la segunda zona normal, sólo se abre la mitad de los contratos y se redefine el stop loss.



## 2. Apertura tardiva de la posición

Si el precio es positivo o negativo y un fuerte contramovimiento negocia el precio hacia la primera zona opuesta con 2-3 velas de 15M, no abrimos una posición allí. Cambiamos el gráfico a 5M Heikin Ashi y esperamos hasta se produzca una vela de giro o simplemente no operamos.



## Tecnología de negociación y ejecución de órdenes

Un enfoque de trading sistemático con elementos discretos requiere una presencia cercana a la pantalla. Por ejemplo, después de que se haya creado el marco de negociación, se debe establecer una alarma a 10 puntos delante las zonas. Las órdenes con objetivo de ganancias y límite de pérdidas también deben realizarse con anticipación. A veces los precios cruzan las zonas dinámicamente, tocan la línea de zonas con inversión inmediata o se quedan 1- 3 puntos cortos.

Un trader capacitado podrá, por ejemplo, retener una orden limitada hasta después de que salte la alarma para obtener así un reinicio inmediato sin tener que ejecutar la orden de antemano. Lo cual también se aplica a la toma de ganancias.

## operativa de trading /ejecución de órdenes

Consejos prácticos para el trading hasta las 14:30h

El precio de apertura a las 8:00h está determinado por los eventos de la noche y todos los eventos y resultados de las bolsas asiáticas están incluidos en DJIA FUT.

El canal de noticias bursátiles CNBC, que también puede recibirse en E, publica el llamado Indicador Over Night en el premercado de 7:30h a 8:00h. Investing.com/indices/indices-cfds también proporciona una buena visión general.

## Ejemplos: DFDs

| Markt             | Größe | Level | Aktuell  | Stop | Limit | Orderart |
|-------------------|-------|-------|----------|------|-------|----------|
| ● Deutschland ... | -1    | 12546 | 12531.0▲ | 70   | 30    | Limit    |
| ● Deutschland ... | -2    | 12581 | 12531.0▲ | 35   | 35    | Limit    |
| ● Deutschland ... | +1    | 12453 | 12533.0▲ | 70   | 30    | Limit    |
| ● Deutschland ... | +2    | 12418 | 12533.0▲ | 35   | 35    | Limit    |

.Un operador experto ya puede mantener una orden de stop en posición de espera después de la alarma para captar un restablecimiento inmediato sin la ejecución de la orden previa. Además, las órdenes pueden ser movidas hacia arriba o hacia abajo del gráfico. La intuición y la práctica hacen al maestro.





## Gestión del dinero y del riesgo

La gestión de las pérdidas tiene lugar en dos niveles

1. intradía stop de pérdida fija 35 puntos por debajo y por encima de la segunda zona de acción. además hay un stop de tiempo poco antes de las 14:30h cuando el precio se consolida lateralmente en las zonas y las posiciones están en pérdida.

2. en el marco de tiempo superior de cobertura de beneficios por la gestión de capital. Los incrementos de posición tienen lugar por etapas después de una curva de capital positiva. La reducción de la posición después de un reajuste. Tan pronto como la pérdida alcanza la mitad del último nivel de aumento, el tamaño de la posición se retrocede en dos pasos. El reglamento intradía establece un marco con aperturas de posiciones, toma de ganancias y limitación de pérdidas. El valor positivo esperado o factor de beneficio puede ser determinado minuciosamente y con exactitud por un observador interesado mediante un backtest manual.

No operamos:

Entre la Navidad y la Epifanía

Los viernes después de cerrar XETRA-DAX a las 17:30h

## Resumen

La estrategia presentada tiene un potencial de beneficios muy alto y es fácil de aplicar sin prisa teniendo un conocimiento preciso de las normas y reglamentos. Tiene elementos discrecionales y por lo tanto una presencia cercana a la plataforma de trading es esencial.